

RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 29/11/2019

O Relatório de Análise de Investimentos (RAI) apresenta os principais pontos de acompanhamento da carteira de investimentos, sob os aspectos de alocação, concentração e retorno. Apresenta, também, algumas evoluções relevantes para o entendimento do comportamento da carteira ao longo do tempo. As informações apresentadas foram extraídas dos relatórios de risco de mercado já produzidos pela ADITUS. A seguir, uma fotografia da alocação segregada por mandatos ou segmentos, de acordo com as especificações da Política de Investimentos.

| VEÍCULO DE INVESTIMENTO | ALOCAÇÃO (R\$) | GESTOR | % PL FUNDO | RISCO DE MERCADO | RENTABILIDADE* | | | | | | | |
|---|---------------------|---------------|------------|------------------|----------------|--------------|--------------|--------------|--------------|---------------|---------------|--------|
| | | | | | 1M | 3M | 6M | ANO | 12M | 24M | 36M | |
| Renda Fixa | 6.676.424,80 | 100% | | | 0,71% | 1,84% | 3,70% | 8,54% | 8,96% | 20,51% | 32,27% | |
| Benchmark: | IPCA + 4% a.a. | | | | 0,82% | 1,58% | 2,91% | 6,91% | 7,41% | 16,19% | 24,20% | |
| Renda Fixa ALM | 5.993.110,08 | 89,79% | | | | | | | | | | |
| RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO CARTEIRA PRC | 5.993.110,08 | 89,79% | 100% | | 0,77% | 1,99% | 3,99% | 9,31% | 9,75% | 21,95% | 35,67% | |
| Benchmark: | IPCA + 4,39% a.a. | | | | 0,85% | 1,67% | 3,11% | 7,28% | 7,81% | 17,06% | 25,60% | |
| Renda Fixa CDI | 683.314,72 | 10,24% | | 0,00% | | | | | | | | |
| BRAM FI RF REF DI FEDERAL II | 683.314,72 | 10,24% | BRADESCO | 0,01% | 0,00% | 0,38% | 1,32% | 2,88% | 5,53% | 6,04% | 12,84% | 24,87% |
| Benchmark: | CDI | | | | 0,38% | 1,33% | 2,90% | 5,57% | 6,09% | 12,96% | 24,92% | |
| Total | 6.674.720,95 | 100% | | 0,00% | 0,71% | 1,84% | 3,70% | 8,54% | 8,96% | 20,51% | 32,27% | |
| Benchmark: | IPCA + 4,39% a.a. | | | | 0,85% | 1,67% | 3,11% | 7,28% | 7,81% | 17,06% | 25,60% | |

* As rentabilidades dos fundos de investimentos foram obtidas através dos valores das cotas desses fundos, não refletindo, portanto, eventuais movimentações feitas pela EFPC.

- O valor Total apresentado é o Patrimônio Líquido extraído através do arquivo XML do Plano.

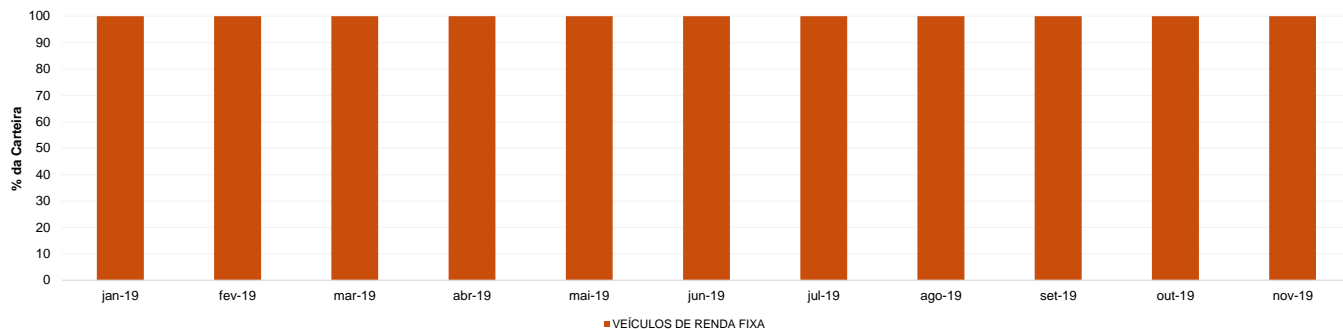
Esse documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados. A ADITUS não se responsabiliza pela utilização das informações aqui contidas para outras finalidades que não sejam meramente informativas.

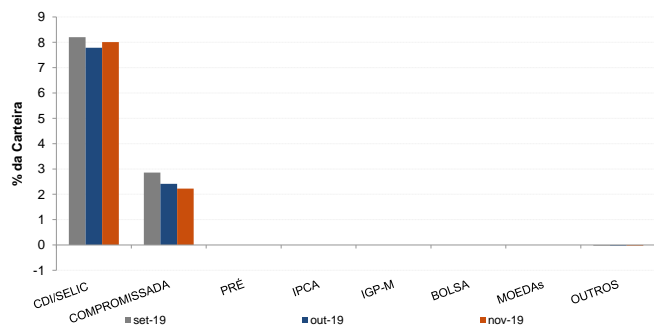
Distribuição da Carteira

O gráfico abaixo apresenta a evolução da carteira de acordo com os segmentos previstos na legislação vigente. A seguir, a exposição por fatores de risco mostra a carteira aberta e os principais fatores de risco que contribuem para a sua exposição ao mercado. A evolução da duration apresenta os principais fatores de risco ao longo do tempo.

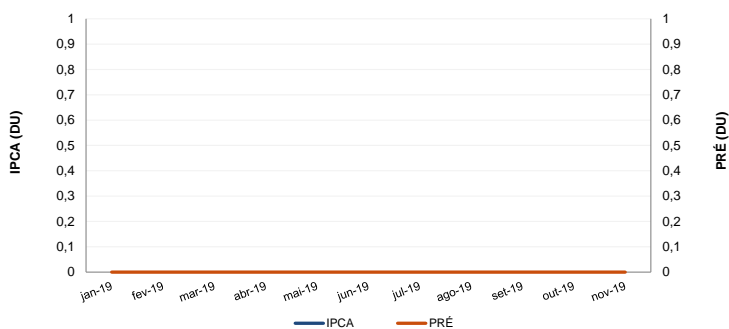
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 29/11/2019

Análises de Contrapartes

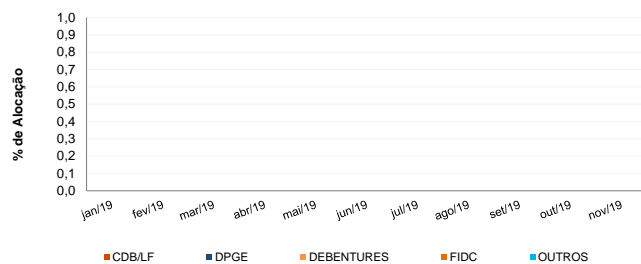
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do último ano.

Empresas Emissoras e Ratings de Longo Prazo

| Nome | MtM* | % | Fitch | Moody's | S&P |
|------|------|---|-------|---------|-----|
|------|------|---|-------|---------|-----|

* em mil R\$

Alocação Por Tipo de Crédito



Mudanças de Rating no Mês

A tabela seguinte apresenta os títulos de crédito privado que tiveram sua classificação alterada ao longo do último mês. As alterações são checadas primeiro verificando o rating da emissão e, em seguida, do emissor.

| Títulos Privados | Valor (mil R\$) | Contraparte | Anterior | Atual | Agência | Venc. | Index. | Taxa | Veículo |
|------------------|-----------------|-------------|----------|-------|---------|-------|--------|------|---------|
|------------------|-----------------|-------------|----------|-------|---------|-------|--------|------|---------|

Nenhuma mudança de rating encontrada.

RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base:

29/11/2019

Aquisições de Ativos no Mês

As tabelas a seguir apresentam os títulos adquiridos no último mês. Esses dados são extraídos dos arquivos XMLs da carteira e dos fundos com alocação direta.

No caso dos ratings, é apresentada a nota da emissão e, em caso de inexistência de nota, apresenta-se a nota do emissor.

| Títulos Públicos | Vencimento | Valor | Valor (% Cart.) | Indexador | Data Compra | Tx de Compra | Tx Ind. Anbima | Veículo |
|------------------|------------|--------|-----------------|-----------|-------------|--------------|----------------|------------------------------|
| LFT 2020-03-01 | 01-mar-20 | 11.908 | 0,18% | Selic | 28-nov-19 | 0,00% | 0,00% | BRAM FI RF REF DI FEDERAL II |
| LFT 2020-09-01 | 01-set-20 | 774 | 0,01% | Selic | 11-nov-19 | 0,00% | 0,00% | BRAM FI RF REF DI FEDERAL II |
| LFT 2021-03-01 | 01-mar-21 | 893 | 0,01% | Selic | 11-nov-19 | 0,00% | 0,00% | BRAM FI RF REF DI FEDERAL II |
| LFT 2021-09-01 | 01-set-21 | 2.620 | 0,04% | Selic | 11-nov-19 | 0,01% | 0,01% | BRAM FI RF REF DI FEDERAL II |
| LFT 2022-03-01 | 01-mar-22 | 2.977 | 0,04% | Selic | 11-nov-19 | 0,01% | 0,01% | BRAM FI RF REF DI FEDERAL II |
| LFT 2022-09-01 | 01-set-22 | 893 | 0,01% | Selic | 11-nov-19 | 0,01% | 0,01% | BRAM FI RF REF DI FEDERAL II |
| LFT 2023-03-01 | 01-mar-23 | 2.083 | 0,03% | Selic | 11-nov-19 | 0,01% | 0,01% | BRAM FI RF REF DI FEDERAL II |
| LFT 2023-09-01 | 01-set-23 | 595 | 0,01% | Selic | 11-nov-19 | 0,01% | 0,01% | BRAM FI RF REF DI FEDERAL II |

